

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología CEM

30 de noviembre de 2021

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	33	6	24	8	21
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.000	500	1.000	500	1.500
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	185.050	146.150	60.650	5.450	291.250
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	173.835	97.433	55.596	4.088	263.512
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	175.835	97.933	56.596	4.588	265.012
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	27	0	0	17.915	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	287	0
Fórmula seleccionada en el cálculo de K*_{CM}	3	3	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0,16%	0,16%	0,16%	0,70%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	278	156	89	28	422
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2517	0,7953	0,3989	0,5418	0,4935
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,2679	2,1929	1,4352	1,7223	1,5454
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,191%	0,234%	0,210%	0,900%	0,224%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,91	2,34	2,10	9,00	2,24

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología "Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)"

30 de noviembre de 2021

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	33	6	24	8	21
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente	2.000	500	1.000	500	1.500
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	185.050	146.150	60.650	5.450	291.250
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.368	893	0	11	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	1,801%	0,609%	0,160%	0,186%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	18,01	6,09	1,60	1,86	1,60